

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/11/2020

O Relatório de Análise de Investimentos (RAI) apresenta os principais pontos de acompanhamento da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e retorno. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. As informações apresentadas foram extraídas dos relatórios de risco de mercado já produzidos pela ADITUS. A seguir, uma fotografia da alocação segregada por mandatos ou segmentos, de acordo com as especificações da Política de Investimentos.

VEÍCULO DE INVESTIMENTO	ALOCAÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	167,902,593.49	69.34%				0.52%	0.68%	2.38%	5.27%	6.78%	17.99%	27.98%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.36%	4.02%	6.56%	8.83%	10.62%	20.29%	31.00%
Renda Fixa	167,902,593.49	69.34%			0.26%							
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	45,660,796.41	18.86%		100%	0.94%	0.52%	0.68%	3.15%	6.10%	6.10%	16.28%	-
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	21,926,223.18	9.06%	BB	4.66%	0.18%	0.11%	0.24%	0.75%	2.18%	2.54%	8.54%	15.29%
BRADESCO FI MULT FIOPREV	59,452,745.26	24.55%	BRADESCO	100%	0.06%	0.14%	0.34%	0.90%	2.69%	3.05%	9.36%	16.24%
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	39,721,055.35	16.40%	BRADESCO	0.55%	0.16%	0.11%	0.19%	0.72%	2.17%	2.54%	8.60%	15.41%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	81,006.95	0.03%	BRASIL PLURAL	3.33%		0.42%	1.32%	2.81%	5.86%	6.56%	17.01%	28.91%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	18,596.37	0.01%	BRPP	3.01%		0.42%	1.32%	2.81%	5.86%	6.56%	17.01%	28.91%
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	1,042,169.97	0.43%	VILA RICA	0.00%		0.42%	1.32%	2.81%	5.86%	6.56%	17.01%	28.91%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.36%	4.02%	6.56%	8.83%	10.62%	20.29%	31.00%
Renda Variável	55,446,054.29	22.90%				14.95%	7.94%	25.05%	-5.69%	1.68%	24.94%	53.86%
Benchmark:	IBOVESPA					15.90%	9.58%	24.59%	-5.84%	0.61%	21.66%	51.30%
Renda Variável	55,446,054.29	22.90%			12.18%							
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	7,655,741.10	3.16%		100%	21.85%	14.95%	8.15%	18.71%	-5.71%	-	-	-
FIOPREV FIA	47,790,313.19	19.74%	QUELUZ	100%	10.75%	12.83%	5.81%	23.53%	-7.52%	0.15%	26.06%	50.90%
Benchmark:	IBOVESPA					15.90%	9.58%	24.59%	-5.84%	0.61%	21.66%	51.30%
Imobiliário	18,345,061.58	7.58%				1.47%	2.64%	4.40%	7.47%	4.93%	21.50%	30.36%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.36%	4.02%	6.56%	8.83%	10.62%	20.29%	31.00%
CARTEIRA PRÓPRIA IM	11,328,889.96	4.68%										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARI	11,328,889.96	4.68%		100%	1.74%	1.67%	2.19%	3.90%	7.52%	-	-	-
Benchmark:	CDI					0.15%	0.46%	1.04%	2.60%	2.99%	9.26%	16.33%
Imóveis	5,318,900.01	2.20%				-0.32%	0.43%	1.59%	3.99%			
FII	1,697,271.61	0.70%										
VECTOR LAJES FII	1,697,271.61	0.70%	QUELUZ	0.00%		-3.75%	1.84%	3.90%	5.76%	-12.77%	-26.79%	-21.67%
Benchmark:	IFIX					1.51%	0.95%	5.68%	-12.17%	-2.83%	22.09%	26.91%
Operações com Participantes	432,724.96	0.18%				-2.35%	2.10%	1.56%	-8.08%	-9.75%	85.71%	139.50%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.36%	4.02%	6.56%	8.83%	10.62%	20.29%	31.00%
Total	242,131,416.45	100%			3.06%	3.56%	2.41%	6.95%	2.86%	5.45%	20.04%	33.64%
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					1.28%	3.78%	6.04%	7.89%	9.58%	18.03%	27.32%

* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatório foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC.

O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

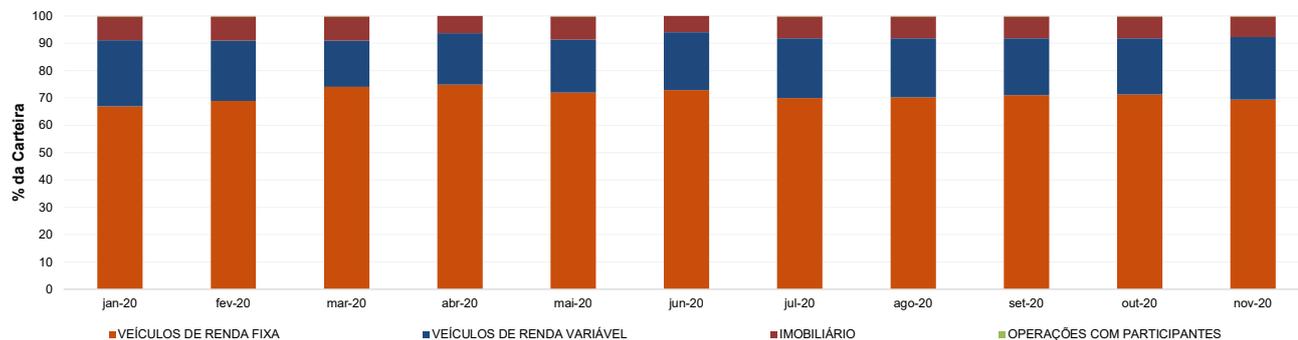
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

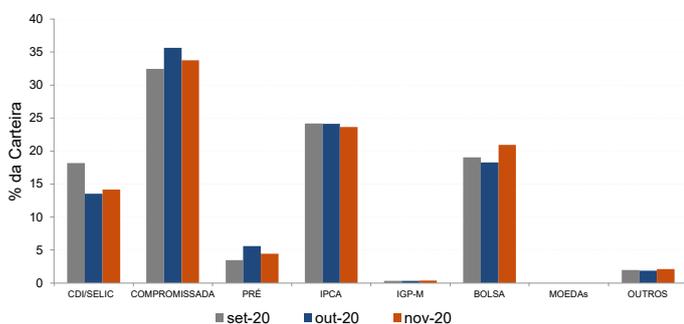
Distribuição da Carteira

O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais fatores de risco ao longo do tempo.

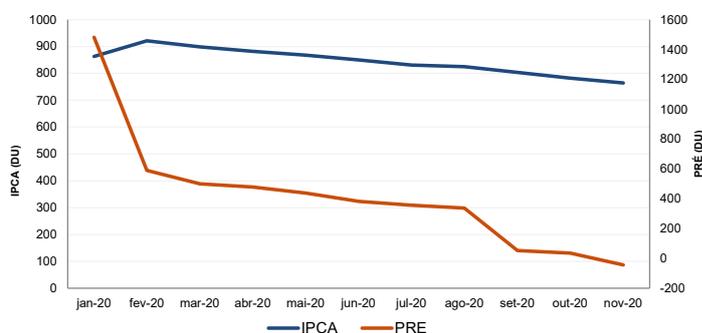
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Renda Variável

Essa seção abrange análises sobre a carteira de Renda Variável. Todas as informações sobre concentração são relativas ao total da carteira de Renda Variável do plano.

Maiores Exposições

A análise de maiores exposições apresenta as ações com maior participação na carteira, o setor ao qual pertencem e a evolução da posição em relação ao mês anterior.

Nome	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	8,565.18	16.66	6,649.00	15.39
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	4,012.36	7.80	3,051.97	7.07
SUZB3	Madeira e Papel	3,339.15	6.50	1,771.77	4.10
VVAR3	Comércio	3,337.00	6.49	3,226.08	7.47
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	3,182.57	6.19	2,047.11	4.74
GBR4	Siderurgia e Metalurgia	3,159.48	6.15	3,049.04	7.06
CSNA3	Siderurgia e Metalurgia	3,075.11	5.98	0.00	
MOVI3	Diversos	2,954.77	5.75	1,895.63	4.39
MGLU3	Comércio	2,737.80	5.33	3,224.07	7.46
BIDI11	Intermediários Financeiros	2,244.70	4.37	1,565.56	3.62

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

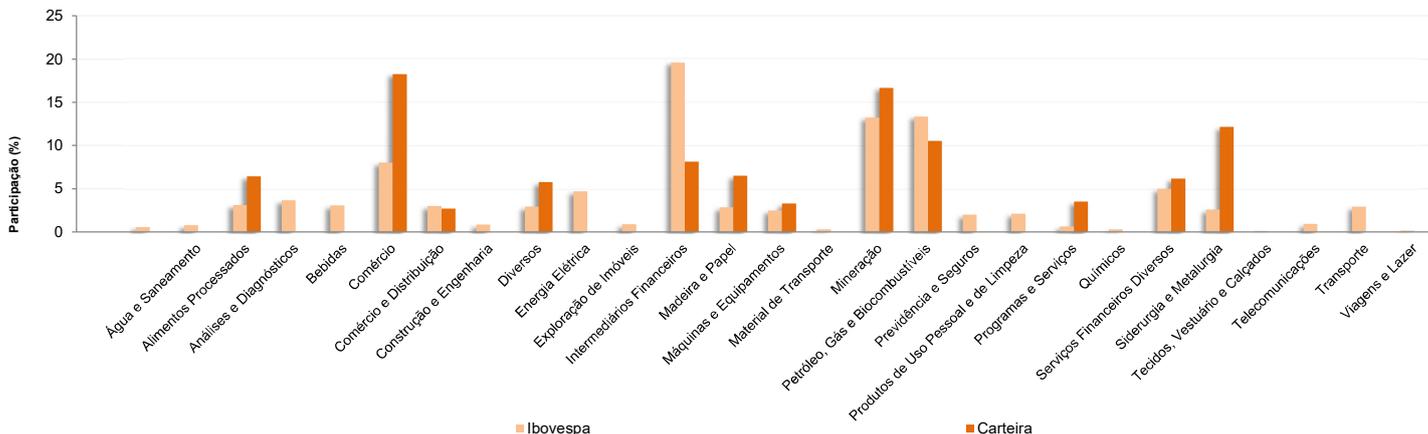
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
VALE3	8,565.18	16.66	0.00	1
PETR4	4,012.36	7.80	0.00	1
SUZB3	3,339.15	6.50	0.01	1
VVAR3	3,337.00	6.49	0.01	1
B3SA3	3,182.57	6.19	0.00	1
GBR4	3,159.48	6.15	0.01	1
CSNA3	3,075.11	5.98	0.02	1
MOVI3	2,954.77	5.75	0.11	1
MGLU3	2,737.80	5.33	0.00	1
BIDI11	2,244.70	4.37	0.00	1

* em mil R\$

Concentração por setor

A concentração por setor segrega as ações da carteira em setores da Bovespa e compara os percentuais de alocação da carteira com os do benchmark de renda variável.



Análises de Contrapartes

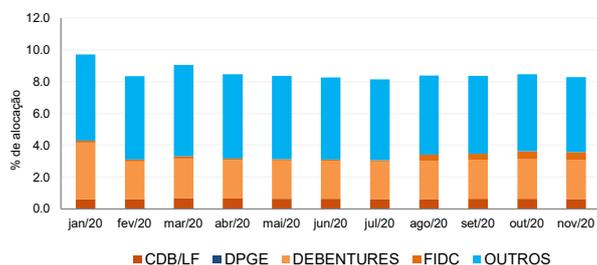
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
RB CAPITAL SECURITIZADORA SA	10,271.66	4.35	Sem Faixa
VALE SA	8,565.18	3.63	Faixa 1
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	5,786.14	2.45	Faixa 3
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	4,012.36	1.70	Faixa 2
SUZANO S.A.	3,339.15	1.41	Faixa 1
VIA VAREJO SA	3,337.00	1.41	Sem Faixa
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	3,182.57	1.35	Sem Faixa
GERDAU SA	3,159.48	1.34	Faixa 1
CIA SIDERURGICA NACIONAL	3,075.11	1.30	Faixa 5
MOVIDA PARTICIPACOES	2,954.77	1.25	Faixa 2

* em mil R\$

Alocação Por Tipo de Crédito



Mudanças de Faixa de Risco de Crédito no Mês

A tabela seguinte apresenta os títulos de crédito privado que tiveram sua classificação alterada ao longo do último mês. As alterações são checadas primeiro verificando a faixa correspondente da emissão e, em seguida, do emissor.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Faixa Anterior	Faixa Atual	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/11/2020

Aquisições de Ativos no Mês

As tabelas a seguir apresentam os títulos adquiridos no último mês. Esses dados são extraídos dos arquivos XMLs da carteira e dos fundos com alocação direta.

É apresentada a faixa de risco de crédito da emissão e, em caso de inexistência, apresenta-se a faixa do emissor.

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2021-03-01	01-mar-21	426,251	0.18%	Selic	16-nov-20	6.00%	0.06%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	29,795	0.01%	Selic	16-nov-20	6.00%	0.06%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

